



TITLE:

保側な流れに対する加法過程のエ ルゴード的性質 (コロフキン型近似 定理)

AUTHOR(S):

佐藤, 亮太郎

CITATION:

佐藤, 亮太郎. 保側な流れに対する加法過程のエルゴード的性質 (コロフキン型近似定理). 数理解析研究所講究録 2002, 1243: 45-48

ISSUE DATE:

2002-01

URL:

<http://hdl.handle.net/2433/41658>

RIGHT:

保測な流れに対する加法過程の エルゴード的性質

岡山大・自然 佐藤亮太郎 (Ryotaro Sato)

Graduate School of Natural Science and Technology

Okayama University

ここでは、確率空間上の保測な流れに対する加法過程のエルゴード的性質について調べる。

$\{T_t\}$: 確率空間 (Ω, Σ, μ) 上の保測な流れ (可測性は仮定する), $\mathbf{F} = \{F_t : t > 0\} \subset L_p(\mu)$

とする.

$$\text{加法過程} \stackrel{\text{def}}{=} F_{t+s} = F_t + F_s \circ T_t \quad (\forall t, s > 0)$$

$$(T_t F_s = F_s \circ T_t \text{ と書く})$$

【一般に, p は $0 \leq p \leq \infty$ の範囲で考えられるが, 簡単のために, $p = 1$ とする】 $t \mapsto F_t$

が可測関数であれば, \mathbf{F} の形が次のように決定する:

$$\exists f_1 \in L_1 \text{ such that } F_t = T_t f_1 - f_1 + \int_0^t T_s F_1 ds, \quad t > 0.$$

$$\therefore \frac{F_t}{t} = \frac{1}{t}(T_t f_1 - f_1) + \frac{1}{t} \int_0^t T_s F_1 ds,$$

【注： $f_1 = -\int_0^1 F_s ds$ となる】

ここで、 $\lim_{t \rightarrow \infty} \frac{1}{t} \int_0^t T_s F_1 ds$ について：（概収束、ノルム収束は OK）

$$\lim_{t \downarrow 0} \frac{1}{t} \int_0^t T_s F_1 ds = F_1 \text{ について：（概収束、ノルム収束は OK）}$$

（新しい加法過程） $G_t = T_t f_1 - f_1, t > 0$ について：

$\lim_{t \rightarrow \infty} \frac{1}{t} G_t = 0$. （ノルム収束は OK ← 自明） 一般に、概収束は NO. ここで、

$$G^*(\cdot) \stackrel{\text{def}}{=} \text{ess sup}_{0 \leq r < s < 1} |T_s f_1(\cdot) - T_r f_1(\cdot)|$$

として、 $G^* \in L_1$ ならば、概収束の意味で、

$$\lim_{t \rightarrow \infty} \frac{1}{t} G_t = 0. \text{ (OK)}$$

次に、 $\{G_t\}$ が linearly bounded, i.e.

$$(*) \quad \sup_{t>0} \left\| \frac{1}{t} (T_t f_1 - f_1) \right\|_1 < \infty \quad [\Leftrightarrow \sup_{t>0} \frac{1}{t} \|F_t\|_1 < \infty]$$

を仮定すれば、 $\exists f_0(\xi) = \lim_{t \downarrow 0} \frac{1}{t} (T_t f_1(\xi) - f_1(\xi))$ (a.a. $\xi \in \Omega$).

【ここで、一般にノルム収束は NO. また、(*) を仮定しないと、 $G^* \in L_1$ としても、この概

収束は NO となることがある】 この f_0 を使って、 \mathbf{F} のもう一つの表現が可能：

$$\left\{ \begin{array}{l} F_t = G_t + \int_0^t T_s F_1 ds = G_t - \int_0^t T_s f_0 ds + \int_0^t T_s (f_0 + F_1) ds \\ \\ = H_t + \int_0^t T_s (f_0 + F_1) ds, \quad t > 0. \end{array} \right.$$

ここで, $\lim_{t \downarrow 0} \frac{1}{t} H_t(\xi) = 0$ for a.a. $\xi \in \Omega$. これより, 次が成立する:

\exists (singular) 加法過程 $\{\widehat{H}_t : t > 0\} \subset L_1^+(\mu)$ such that

$$|H_t| \leq \widehat{H}_t \quad \text{and} \quad \lim_{t \downarrow 0} \frac{1}{t} \widehat{H}_t(\xi) = 0 \quad (\text{a.a. } \xi \in \Omega).$$

次に,

$A: \{T_t\}$ を L_1 上の作用素半群と見て, その生成作用素,

$E: A$ の値域とする. この時, (*) の仮定なしに, 以下が成立する.

【注: $\overline{E} = E \Leftrightarrow \{T_t\}$ が一様平均エルゴード定理を満たす】

定理. (I) $F_1 \notin \overline{E} \Leftrightarrow \lim_{t \rightarrow \infty} \frac{1}{t} \|F_t\|_1 > 0$.

(II) $F_1 \in \overline{E} \setminus E \Leftrightarrow \lim_{t \rightarrow \infty} \frac{1}{t} \|F_t\|_1 = 0$ and $\lim_{b \rightarrow \infty} \frac{1}{b} \int_0^b \|F_t\|_1 dt = \infty$.

(III) $F_1 \in E \Leftrightarrow \exists \tilde{f} \in L_1 : F_t = T_t \tilde{f} - \tilde{f}, t > 0 \Leftrightarrow \sup_{t > 0} \|F_t\|_1 < \infty$

$$\Leftrightarrow \liminf_{b \rightarrow \infty} \frac{1}{b} \int_0^b \|F_t\|_1 dt < \infty.$$

命題. $\{F_t : t > 0\}$ が absolutely continuous 【i.e. $\exists f \in L_1$ such that F_t

$$\int_0^t T_s f ds, \quad t > 0 \text{】} \Leftrightarrow f_1 [-\int_0^1 F_s ds] \in (A \text{ の定義域}).$$

$$\exists f, g \in L_1 \text{ such that } F_t = T_t f - f = \int_0^t T_s g \, ds \quad (\forall t > 0)$$

$$\Leftrightarrow \sup_{t>0} \|F_t\|_1 < \infty \text{ and } \lim_{t \downarrow 0} \left\| \frac{F_t}{t} - g \right\|_1 = 0 \text{ for some } g \in L_1$$

$$\Leftrightarrow \liminf_{b \rightarrow \infty} \frac{1}{b} \int_0^b \|F_t\|_1 \, dt < \infty \text{ and } \int_0^1 F_s \, ds \in (A \text{ の定義域}).$$

【 $p \neq 1$ なる場合も, $\{F_t\}$ が適当な $\tilde{f} \in L_p$ で, $F_t = T_t \tilde{f} - \tilde{f}$, $t > 0$ なる形に書ける条件についての考察がある. これについては, 流れ $\{T_t\}$ と加法過程 $\{F_t\}$ から自然に導かれる skew product flow の不変測度の存在との関連付けが一般に可能である】

Ryotaro Sato

Department of Mathematics

Okayama University

Okayama, 700-8530 Japan

E-mail address: satoryot@math.okayama-u.ac.jp